

JPMorgan Funds - Diversified Risk Fund D (acc) EUR (hedged)

Categoria Morningstar™

Alt - Multistrategy

Benchmark Morningstar

Morningstar Euro Cautious Global Target

Allocation NR EUR

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

ICE BofA SOFR Overnight Rate TR USD

Morningstar Rating™

★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

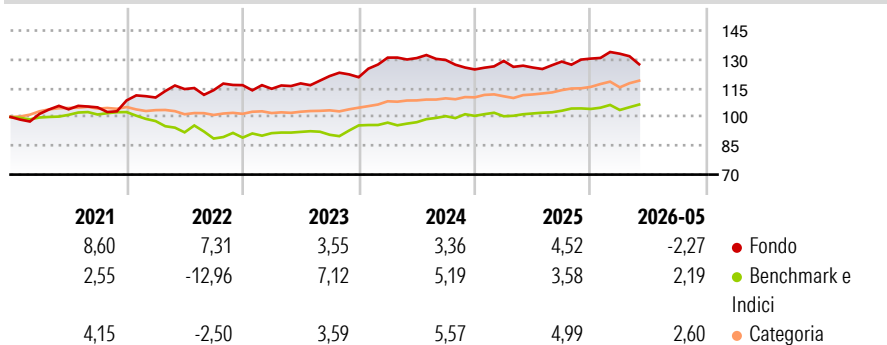
Il Comparto mira ad offrire la crescita del capitale nel lungo periodo investendo in molteplici classi di attivo su scala globale, impiegando un approccio all'asset allocation ponderato per il rischio e utilizzando strumenti finanziari derivati ove appropriato. La maggior parte degli attivi del Comparto sarà investita, direttamente o tramite strumenti finanziari derivati, in titoli azionari (comprese società a bassa capitalizzazione), titoli convertibili, titoli di debito (compresi i titoli con rating inferiore a investment grade o sprovvisti di rating), valute, liquidità e strumenti equivalenti. Il Comparto può altresì acquisire un'esposizione alle commodity tramite azioni, OICVM o altri OICR, o strumenti finanziari derivati su indici...

Misure di Rischio

3Y Alpha	0,98	3Y Sharpe Ratio	0,07
3Y Beta	-0,29	3Y Std Dev	5,47
3Y R-Squared	4,99	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	-0,25	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	7,56	10Y Risk	+Med

Basati su Morningstar Euro Cautious Global Target Allocation NR EUR (dove applicabile)

Rendimenti



Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	-0,38	3,57	3,69	2026	1,95	-	-	-
6-Mesi	1,62	2,61	3,89	2025	3,54	-2,65	2,47	1,20
1-Anno	4,96	5,16	8,62	2024	8,45	-0,18	-0,75	-3,80
3-Anni Ann.ti	4,04	5,10	6,67	2023	-1,62	2,44	3,27	-0,50
5-Anni Ann.ti	4,89	1,18	4,26	2022	1,41	3,99	-0,52	2,29
10-Anni Ann.ti	-0,40	2,07	2,49					

Rendimenti aggiornati al 26/06/2026

Portafoglio 31/05/2026



Asset Allocation %	Netta
Azioni	53,95
Obbligazioni	32,90
Liquidità	16,76
Altro	-3,61

Fixed Income Style

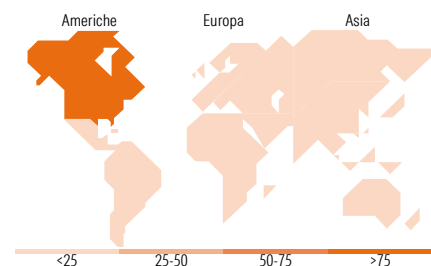
Box™

Qualità Credito	
Alto	Basso
Alto	Alto
Med	Med
Basso	Basso

Sensibilità ai Tassi

Duration Effettiva -
Maturità effettiva -
Qualità Credito Media

Fondo



Titoli principali

Nome	Settore	%
JPM USD Liquidity LVNAV X...	—	5,72
United States Treasury Bills...	—	4,88
United States Treasury Bills...	—	3,01
United States Treasury Bills...	—	2,95
CommodityIndexSwap TR...	—	0,37
Moss Creek Resources...	—	0,33
Xhr LP 4.875%	—	0,33
Versant Media Group Inc. 7.25%	—	0,33
Kioxia Holdings Corp. 6.25%	—	0,33
Enova International Inc...	—	0,33
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		18,57
Numero Complessivo di Titoli Azionari		339
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		125

Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
🏛️ Governativo	21,94
🏢 Societario	50,37
🏠 Cartolarizzazioni	0,00
🏘️ Enti Locali	0,00
🏢 Liquidità ed equivalenti	26,89
📄 Derivati	0,79

Coupon Range %

	Fondo
0 coupon	23,84
Da 0 a 4 cedole	9,41
Da 4 a 6 cedole	26,09
Da 6 a 8 cedole	22,28
Da 8 a 10 cedole	15,57
Da 10 a 12 cedole	1,96
Oltre 12 cedole	0,85

Ripartizione Geografica %

	Fondo
America	76,00
Stati Uniti	70,51
Canada	5,49
America Latina e Centrale	0,00
Europa	1,01
Regno Unito	0,01
Europa Occidentale - Euro	0,13
Europa Occidentale - Non Euro	0,87
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	0,00
Asia	23,00
Giappone	19,53
Australasia	2,58
Asia - Paesi Sviluppati	0,01
Asia - Emergente	0,88

Anagrafica

Società di Gestione	JPMorgan Asset Management (Europe) S.à r.l.	Patrimonio Classe (Mln)	3,10 EUR	Investimento Min. Ingresso	5.000 EUR
		(26/06/2026)		Investimento Min. Successivo	1.000 EUR
		Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	2,20%
Telefono	+352 34 101	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	2,20%
Web	http://www.jpmorganassetmanagement.com	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
		Inc/Acc	Acc		
		ISIN	LU0875418351		

See disclosures for more details

© 2026 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotte; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.

JPMorgan Funds - Diversified Risk Fund D (acc) EUR (hedged)

Data di Partenza	11/04/2013
Nome del Gestore	Yazann Romahi
Data Inizio Gestione	08/02/2013
NAV ^(26/06/2026)	EUR 77,69
Patrimonio Netto (Mln) ^(31/05/2026)	130,57 USD